

# 长盛可转债债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 20 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长盛可转债
基金主代码	003510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日
报告期末基金份额总额	110,244,969.48 份
投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上，以可转债为主要投资标的，力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、大类资产配置</p> <p>本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 可转债投资策略：本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。</p>

	(2) 普通债券投资策略：本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。	
业绩比较基准	中证可转债债券指数收益率*60%+中证综合债券指数收益率*30%+沪深 300 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛可转债 A	长盛可转债 C
下属分级基金的交易代码	003510	003511
报告期末下属分级基金的份额总额	44,923,116.35 份	65,321,853.13 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	长盛可转债 A	长盛可转债 C
1. 本期已实现收益	-2,197,655.65	-3,267,638.28
2. 本期利润	-1,482,670.92	-2,252,859.66
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0325	-0.0337
4. 期末基金资产净值	42,479,793.77	61,624,356.74
5. 期末基金份额净值	0.9456	0.9434

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到 2023 年 12 月 31 日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛可转债 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④

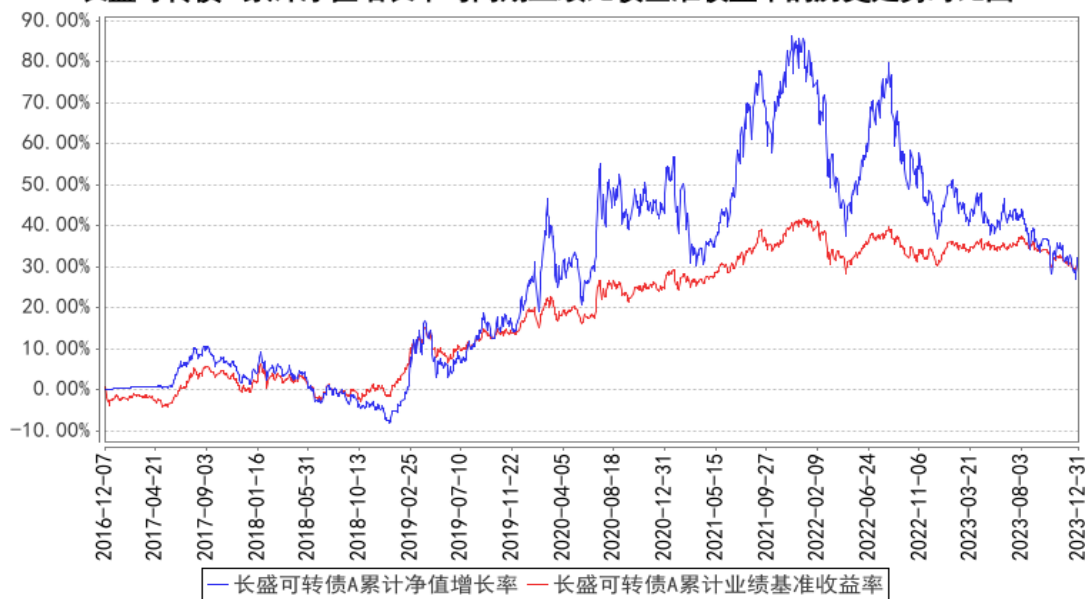
				④		
过去三个月	-3.26%	0.78%	-2.25%	0.32%	-1.01%	0.46%
过去六个月	-7.28%	0.75%	-2.73%	0.29%	-4.55%	0.46%
过去一年	-5.54%	0.79%	0.00%	0.30%	-5.54%	0.49%
过去三年	-10.56%	1.20%	3.84%	0.41%	-14.40%	0.79%
过去五年	42.83%	1.22%	32.98%	0.47%	9.85%	0.75%
自基金合同 生效起至今	32.18%	1.05%	31.21%	0.46%	0.97%	0.59%

长盛可转债 C

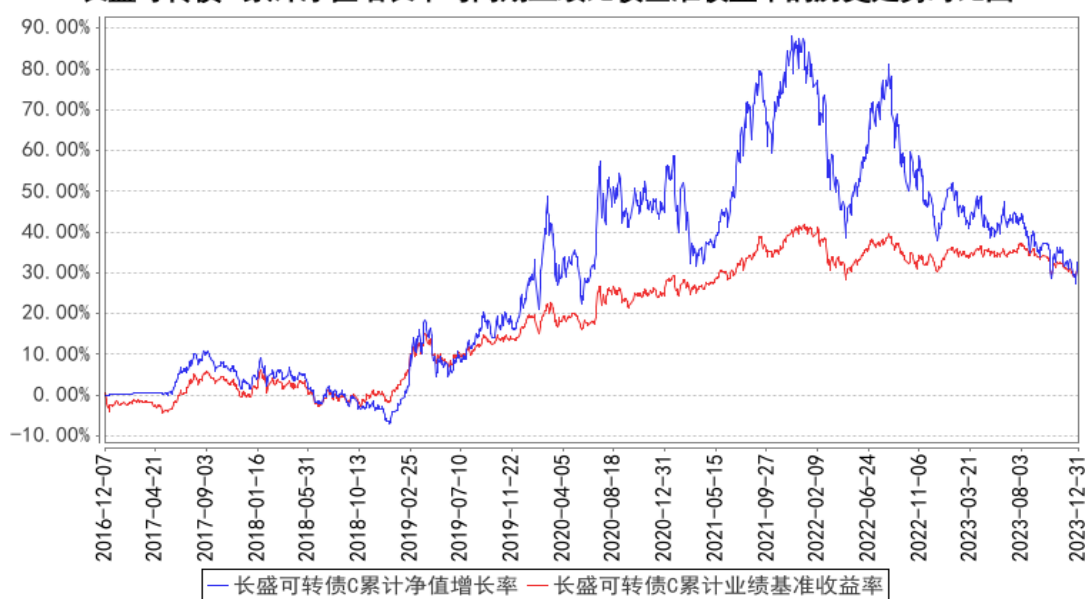
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-3.34%	0.78%	-2.25%	0.32%	-1.09%	0.46%
过去六个月	-7.41%	0.75%	-2.73%	0.29%	-4.68%	0.46%
过去一年	-5.83%	0.79%	0.00%	0.30%	-5.83%	0.49%
过去三年	-11.36%	1.20%	3.84%	0.41%	-15.20%	0.79%
过去五年	41.55%	1.22%	32.98%	0.47%	8.57%	0.75%
自基金合同 生效起至今	32.67%	1.05%	31.21%	0.46%	1.46%	0.59%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛可转债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛可转债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨哲	本基金基金经理，长盛积极	2018年6	-	13年	杨哲先生，硕士。曾任大公公

	配置债券型证券投资基金基金经理，长盛安盈混合型证券投资基金基金经理。	月 11 日		际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。
--	------------------------------------	--------	--	--

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

报告期内，受低基数效应等因素影响，多数经济指标回升向好；但消费环比走弱，房地产投资增速继续下滑，显示经济复苏基础仍不牢固。物价方面，CPI 和 PPI 同比均转弱，显示需求相对疲弱。宏观调控组合政策有所发力，加快城中村改造、城投化债、增发长期建设国债、新增抵押补充贷款 PSL 等稳增长措施陆续落地。

报告期内，债券收益率总体呈现震荡下行走势。10 月至 12 月初，受资金利率阶段上行、增发国债、多地放松地产政策等因素影响，债券收益率震荡调整；12 月初以来，随着市场预期逐渐消化，且重要会议并未出台超预期政策，债券收益率开始快速下行，信用利差、期限利差大幅收窄。

权益市场方面，A 股呈现震荡下跌走势。从行业结构来看，申万一级行业指数中，仅煤炭、电子、农林牧渔等行业指数上涨，其余行业指数均为下跌，其中美护、房地产、建材、商贸、电力设备等行业指数跌幅较大。

可转债方面，转债市场整体跟随股市震荡下跌。可转债价格中位数处于近两年中枢附近，转股溢价率有所压缩，其中偏股型转债转股溢价率回落较多。

##### 2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，在市场主线不清、经济缺乏亮点环境下，结合权益市场行情，动态优化了行业配置，减持了部分高价转债和高溢价率个券，并降低了股票仓位；同时，积极参与可转债新券的发行申购和配售，增厚组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛可转债 A 的基金份额净值为 0.9456 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.26%，同期业绩比较基准收益率为 -2.25%；截至本报告期末长盛可转债 C 的基金份额净值为

0.9434 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.34%，同期业绩比较基准收益率为-2.25%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,839,027.32	8.51
	其中：股票	10,839,027.32	8.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	113,497,848.86	89.07
	其中：债券	113,497,848.86	89.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	200,064.60	0.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,791,317.97	1.41
8	其他资产	1,101,036.44	0.86
9	合计	127,429,295.19	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,690,058.90	7.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	717,840.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,431,128.42	2.34
J	金融业	-	-



K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业		-
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	10,839,027.32	10.41

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	40,000	1,378,000.00	1.32
2	688008	澜起科技	19,500	1,145,820.00	1.10
3	603296	华勤技术	9,000	719,010.00	0.69
4	000034	神州数码	24,000	717,840.00	0.69
5	688595	芯海科技	16,000	692,800.00	0.67
6	688047	龙芯中科	5,000	553,050.00	0.53
7	002036	联创电子	53,000	541,130.00	0.52
8	300556	丝路视觉	14,000	515,900.00	0.50
9	002436	兴森科技	35,000	515,550.00	0.50
10	000933	神火股份	30,000	504,000.00	0.48

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,428,257.53	5.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	108,069,591.33	103.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,497,848.86	109.02

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110062	烽火转债	56,280	6,289,197.48	6.04
2	019709	23 国债 16	54,000	5,428,257.53	5.21
3	123076	强力转债	37,800	4,337,223.78	4.17
4	127049	希望转 2	41,001	4,281,537.85	4.11
5	123107	温氏转债	29,870	3,780,924.14	3.63

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货投资。

**5.9.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**5.10 投资组合报告附注****5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

## 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,461.84
2	应收证券清算款	1,064,325.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,248.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,101,036.44

## 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110062	烽火转债	6,289,197.48	6.04
2	123076	强力转债	4,337,223.78	4.17
3	127049	希望转 2	4,281,537.85	4.11
4	123107	温氏转债	3,780,924.14	3.63
5	113643	风语转债	3,709,245.09	3.56
6	113061	拓普转债	3,513,780.76	3.38
7	113050	南银转债	3,426,464.57	3.29
8	132018	G 三峡 EB1	3,109,799.57	2.99
9	113045	环旭转债	2,988,428.65	2.87
10	113064	东材转债	2,981,238.38	2.86
11	110088	淮 22 转债	2,947,670.23	2.83
12	113602	景 20 转债	2,748,193.96	2.64
13	118025	奕瑞转债	2,541,670.30	2.44
14	113639	华正转债	2,520,543.27	2.42
15	113619	世运转债	2,511,767.05	2.41
16	113563	柳药转债	2,506,811.59	2.41
17	128137	洁美转债	2,436,843.05	2.34
18	127045	牧原转债	2,433,128.16	2.34
19	113530	大丰转债	2,151,901.28	2.07
20	123172	漱玉转债	2,120,956.30	2.04
21	113615	金诚转债	1,935,297.53	1.86
22	127012	招路转债	1,800,469.90	1.73
23	113616	韦尔转债	1,567,789.73	1.51
24	113044	大秦转债	1,547,202.48	1.49
25	113060	浙 22 转债	1,535,053.31	1.47
26	111004	明新转债	1,501,737.46	1.44
27	113066	平煤转债	1,459,493.74	1.40
28	110073	国投转债	1,423,529.92	1.37

29	113043	财通转债	1,381,215.14	1.33
30	110079	杭银转债	1,332,649.23	1.28
31	123025	精测转债	1,157,960.33	1.11
32	113021	中信转债	1,156,228.05	1.11
33	127086	恒邦转债	1,121,372.95	1.08
34	113524	奇精转债	1,065,465.68	1.02
35	118004	博瑞转债	943,811.92	0.91
36	123090	三诺转债	710,535.75	0.68
37	127041	弘亚转债	704,145.82	0.68
38	113656	嘉诚转债	671,245.13	0.64
39	123157	科蓝转债	667,793.18	0.64
40	123184	天阳转债	634,881.15	0.61
41	111010	立昂转债	520,123.10	0.50
42	127073	天赐转债	503,098.23	0.48
43	127084	柳工转 2	456,010.41	0.44
44	113058	友发转债	444,195.53	0.43
45	110090	爱迪转债	429,308.06	0.41
46	113048	晶科转债	415,954.92	0.40
47	128106	华统转债	398,657.68	0.38
48	127020	中金转债	392,672.42	0.38
49	127068	顺博转债	351,412.92	0.34
50	127018	本钢转债	333,078.05	0.32
51	128101	联创转债	303,832.11	0.29
52	118035	国力转债	286,528.07	0.28
53	127074	麦米转 2	262,221.36	0.25
54	123194	百洋转债	243,253.98	0.23
55	123099	普利转债	166,842.30	0.16
56	113037	紫银转债	139,470.04	0.13
57	118033	华特转债	123,680.40	0.12
58	132026	G 三峡 EB2	114,306.90	0.11
59	110070	凌钢转债	68,626.93	0.07
60	113667	春 23 转债	66,315.34	0.06
61	118008	海优转债	65,438.93	0.06
62	123192	科思转债	64,571.55	0.06
63	123059	银信转债	53,339.56	0.05
64	123085	万顺转 2	46,895.62	0.05
65	123144	裕兴转债	44,620.47	0.04
66	113648	巨星转债	37,757.52	0.04
67	111001	山玻转债	37,685.04	0.04
68	110059	浦发转债	37,683.06	0.04
69	113631	皖天转债	37,542.30	0.04
70	113062	常银转债	36,993.59	0.04

71	113056	重银转债	36,827.64	0.04
72	118003	华兴转债	36,717.93	0.04
73	110063	鹰 19 转债	36,615.72	0.04
74	113606	荣泰转债	36,437.65	0.04
75	123178	花园转债	36,338.53	0.03
76	118019	金盘转债	36,250.83	0.03
77	127037	银轮转债	36,141.18	0.03
78	110061	川投转债	36,130.24	0.03
79	111000	起帆转债	36,034.41	0.03
80	113055	成银转债	35,925.29	0.03
81	127015	希望转债	35,674.56	0.03
82	113627	太平转债	35,661.63	0.03
83	123121	帝尔转债	35,551.97	0.03
84	127039	北港转债	35,522.30	0.03
85	128135	洽洽转债	35,513.60	0.03
86	123176	精测转 2	35,420.81	0.03
87	127043	川恒转债	35,418.06	0.03
88	113033	利群转债	35,416.96	0.03
89	113641	华友转债	35,337.10	0.03
90	128109	楚江转债	35,311.11	0.03
91	123104	卫宁转债	35,295.92	0.03
92	110067	华安转债	35,252.35	0.03
93	127046	百润转债	35,160.33	0.03
94	127072	博实转债	35,127.18	0.03
95	113065	齐鲁转债	35,118.63	0.03
96	128144	利民转债	35,099.70	0.03
97	128132	交建转债	35,095.52	0.03
98	113063	赛轮转债	35,083.30	0.03
99	113597	佳力转债	35,054.51	0.03
100	127069	小熊转债	35,029.89	0.03
101	123161	强联转债	35,012.96	0.03
102	113623	凤 21 转债	34,982.22	0.03
103	110081	闻泰转债	34,967.87	0.03
104	113663	新化转债	34,965.63	0.03
105	113638	台 21 转债	34,921.97	0.03
106	127054	双箭转债	34,917.42	0.03
107	110043	无锡转债	34,915.84	0.03
108	113582	火炬转债	34,868.60	0.03
109	127032	苏行转债	34,862.59	0.03
110	128129	青农转债	34,839.56	0.03
111	123048	应急转债	34,795.51	0.03
112	127025	冀东转债	34,768.37	0.03

113	113655	欧 22 转债	34,743.48	0.03
114	113516	苏农转债	34,741.22	0.03
115	113650	博 22 转债	34,729.74	0.03
116	110084	贵燃转债	34,720.27	0.03
117	123078	飞凯转债	34,711.32	0.03
118	110085	通 22 转债	34,695.25	0.03
119	110077	洪城转债	34,679.40	0.03
120	113052	兴业转债	34,649.73	0.03
121	113654	永 02 转债	34,640.94	0.03
122	113669	景 23 转债	34,625.67	0.03
123	128128	齐翔转 2	34,617.46	0.03
124	128095	恩捷转债	34,604.61	0.03
125	123145	药石转债	34,544.18	0.03
126	113651	松霖转债	34,541.32	0.03
127	127051	博杰转债	34,521.18	0.03
128	127066	科利转债	34,465.27	0.03
129	113640	苏利转债	34,460.64	0.03
130	127061	美锦转债	34,452.05	0.03
131	110091	合力转债	34,448.80	0.03
132	127017	万青转债	34,412.17	0.03
133	127058	科伦转债	34,409.64	0.03
134	128124	科华转债	34,347.80	0.03
135	113647	禾丰转债	34,343.51	0.03
136	127040	国泰转债	34,324.22	0.03
137	123022	长信转债	34,322.44	0.03
138	113584	家悦转债	34,233.73	0.03
139	113024	核建转债	34,219.94	0.03
140	128134	鸿路转债	34,219.71	0.03
141	127024	盈峰转债	34,160.22	0.03
142	128116	瑞达转债	34,154.08	0.03
143	127050	麒麟转债	34,150.08	0.03
144	113051	节能转债	34,141.54	0.03
145	113042	上银转债	34,134.44	0.03
146	111009	盛泰转债	34,131.29	0.03
147	111011	冠盛转债	34,129.67	0.03
148	127056	中特转债	34,089.59	0.03
149	128136	立讯转债	34,070.23	0.03
150	113579	健友转债	34,062.53	0.03
151	113632	鹤 21 转债	34,061.59	0.03
152	127016	鲁泰转债	34,055.92	0.03
153	110045	海澜转债	34,053.20	0.03
154	128117	道恩转债	34,047.49	0.03

155	123133	佩蒂转债	34,038.58	0.03
156	123035	利德转债	34,019.72	0.03
157	113644	艾迪转债	34,011.97	0.03
158	127067	恒逸转 2	34,009.09	0.03
159	113059	福莱转债	34,008.85	0.03
160	128133	奇正转债	34,006.58	0.03
161	123071	天能转债	33,992.70	0.03
162	113637	华翔转债	33,984.14	0.03
163	118034	晶能转债	33,974.23	0.03
164	110089	兴发转债	33,971.42	0.03
165	113652	伟 22 转债	33,954.66	0.03
166	113053	隆 22 转债	33,949.24	0.03
167	128131	崇达转 2	33,948.52	0.03
168	123132	回盛转债	33,933.72	0.03
169	111013	新港转债	33,932.68	0.03
170	123101	拓斯转债	33,921.29	0.03
171	113636	甬金转债	33,906.99	0.03
172	113598	法兰转债	33,861.44	0.03
173	118024	冠宇转债	33,856.37	0.03
174	127026	超声转债	33,842.67	0.03
175	127053	豪美转债	33,839.94	0.03
176	123169	正海转债	33,800.72	0.03
177	113545	金能转债	33,798.50	0.03
178	127038	国微转债	33,784.88	0.03
179	110087	天业转债	33,778.25	0.03
180	113030	东风转债	33,774.04	0.03
181	127071	天箭转债	33,753.10	0.03
182	113653	永 22 转债	33,730.00	0.03
183	123170	南电转债	33,684.93	0.03
184	123158	宙邦转债	33,669.04	0.03
185	127042	嘉美转债	33,632.34	0.03
186	128125	华阳转债	33,610.07	0.03
187	123117	健帆转债	33,600.25	0.03
188	123115	捷捷转债	33,598.95	0.03
189	127082	亚科转债	33,570.15	0.03
190	118030	睿创转债	33,568.05	0.03
191	123180	浙矿转债	33,548.40	0.03
192	128048	张行转债	33,541.75	0.03
193	127022	恒逸转债	33,528.83	0.03
194	110076	华海转债	33,522.55	0.03
195	127014	北方转债	33,512.27	0.03
196	110093	神马转债	33,465.29	0.03

197	110083	苏租转债	33,455.13	0.03
198	127030	盛虹转债	33,451.44	0.03
199	127031	洋丰转债	33,446.42	0.03
200	113542	好客转债	33,445.08	0.03
201	128121	宏川转债	33,418.53	0.03
202	113054	绿动转债	33,408.57	0.03
203	113659	莱克转债	33,392.14	0.03
204	113588	润达转债	33,388.19	0.03
205	127083	山路转债	33,370.90	0.03
206	123143	胜蓝转债	33,359.30	0.03
207	113532	海环转债	33,356.68	0.03
208	123193	海能转债	33,348.88	0.03
209	123087	明电转债	33,330.39	0.03
210	111002	特纸转债	33,316.00	0.03
211	127052	西子转债	33,308.74	0.03
212	110082	宏发转债	33,307.16	0.03
213	123149	通裕转债	33,293.07	0.03
214	110064	建工转债	33,289.25	0.03
215	111014	李子转债	33,285.68	0.03
216	118000	嘉元转债	33,264.19	0.03
217	113621	彤程转债	33,246.05	0.03
218	128063	未来转债	33,173.35	0.03
219	123179	立高转债	33,169.15	0.03
220	113605	大参转债	33,109.03	0.03
221	113670	金 23 转债	33,066.09	0.03
222	113633	科沃转债	33,043.24	0.03
223	123108	乐普转 2	33,002.14	0.03
224	113660	寿 22 转债	32,977.50	0.03
225	127044	蒙娜转债	32,957.59	0.03
226	111003	聚合转债	32,929.27	0.03
227	127028	英特转债	32,925.31	0.03
228	113537	文灿转债	32,896.26	0.03
229	113666	爱玛转债	32,867.80	0.03
230	123056	雪榕转债	32,852.38	0.03
231	123119	康泰转 2	32,830.73	0.03
232	118005	天奈转债	32,822.88	0.03
233	128130	景兴转债	32,808.83	0.03
234	127070	大中转债	32,804.84	0.03
235	113047	旗滨转债	32,775.34	0.03
236	128142	新乳转债	32,761.81	0.03
237	113549	白电转债	32,761.41	0.03
238	123150	九强转债	32,750.68	0.03



239	123091	长海转债	32,735.88	0.03
240	118023	广大转债	32,728.63	0.03
241	110060	天路转债	32,708.75	0.03
242	113634	珀莱转债	32,653.15	0.03
243	118013	道通转债	32,652.25	0.03
244	118010	洁特转债	32,628.78	0.03
245	110055	伊力转债	32,604.40	0.03
246	128122	兴森转债	32,598.50	0.03
247	118031	天 23 转债	32,557.35	0.03
248	127064	杭氧转债	32,554.75	0.03
249	110075	南航转债	32,401.83	0.03
250	123174	精锻转债	32,400.10	0.03
251	113049	长汽转债	32,312.88	0.03
252	127007	湖广转债	32,169.12	0.03
253	110052	贵广转债	32,060.12	0.03
254	113534	鼎胜转债	31,848.67	0.03
255	113519	长久转债	31,824.26	0.03
256	110048	福能转债	31,772.91	0.03
257	127085	韵达转债	31,768.39	0.03
258	113661	福 22 转债	31,594.89	0.03
259	113658	密卫转债	30,808.81	0.03

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛可转债 A	长盛可转债 C
报告期期初基金份额总额	46,410,294.35	68,119,459.89
报告期期间基金总申购份额	531,659.52	3,330,343.10
减：报告期期间基金总赎回份额	2,018,837.52	6,127,949.86
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	44,923,116.35	65,321,853.13

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

## 7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、长盛可转债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛可转债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2024 年 1 月 20 日